

Fecha de Publicación: 20 de julio de 2013

Fecha de Información: 18 de julio de 2013 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1397,8 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3,4%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Financiero**		Intragrupa y Off-shore***		Otros Agentes		Interbancarios
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	302,6	283,0	32,8	40,8	14,6	26,2	235,6
15-35	304,0	588,3	457,6	71,0	43,7	146,0	87,0
36-60	113,6	42,7	0,0	0,0	22,7	93,6	20,0
61-90	2,1	4,0	0,0	0,0	4,0	2,1	0,0
91-180	58,2	35,5	25,0	0,0	10,5	58,2	0,0
>180	0,7	5,6	0,0	0,0	5,6	0,7	0,0
<b>Total</b>	<b>781,3</b>	<b>959,1</b>	<b>515,4</b>	<b>111,8</b>	<b>101,1</b>	<b>326,9</b>	<b>342,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

\*\*Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

**Cuadro No. 2**

### Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

Rango	Sector Financiero*	Otros Agentes sin intragrupo		Total
	Compras/Ventas	Compras	Ventas	
3-14	2,8 %	2,8 %	0,4 %	2,4 %
15-35	3,7 %	3,7 %	3,7 %	3,7 %
36-60	3,7 %	4,3 %	3,9 %	3,9 %
61-90	-	4,4 %	3,8 %	4,2 %
91-180	-	3,9 %	3,5 %	3,7 %
>180	-	4,0 %	3,4 %	3,9 %
<b>Total</b>	<b>3,1 %</b>	<b>3,7 %</b>	<b>3,3 %</b>	<b>3,4 %</b>

\*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	15 al 19 de julio								22 al 26 de julio				29 de jul. al 2 de agosto			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF					
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V				
Sector Financiero**	102	134	3692	3393	19	115	2937	3175	5	61	1826	2393				
Intragrupa y off-shore***	0	0	2022	1500	0	0	1908	1089	0	0	1350	518				
Otros	134	102	539	1361	115	19	463	1044	61	5	311	575				
<b>Total</b>	<b>236</b>	<b>236</b>	<b>6254</b>	<b>6254</b>	<b>134</b>	<b>134</b>	<b>5307</b>	<b>5307</b>	<b>66</b>	<b>66</b>	<b>3487</b>	<b>3487</b>				

\* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

\*\*Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

\*\*\*Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Tasa de Contado) ^ (360/Plazo)) - 1. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.